IPS Daily Closing Brief

2017-04-27

IRS				91d CD	1.41	(0.00)	CALL	1.22	(-0.01)
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
6M	1.4225	-0.50	1.4295	1.4370	1.4748	1.6725	1.2875	2.8575	1.2875
9M	1.4525	-0.50	1.4570	1.4556	1.4862	1.6850	1.2500	2.8300	1.2500
1Y	1.4775	-0.50	1.4785	1.4705	1.4973	1.6925	1.2200	2.8200	1.2200
1.5Y	1.5225	-0.75	1.5210	1.5081	1.5303	1.7125	1.1900	2.8725	1.1900
2Y	1.5550	-0.75	1.5555	1.5414	1.5628	1.7300	1.1675	2.9350	1.1675
3Y	1.6175	-0.75	1.6170	1.6034	1.6257	1.7850	1.1550	3.0650	1.1550
4Y	1.6700	-0.75	1.6665	1.6543	1.6808	1.8450	1.1575	3.1875	1.1575
5Y	1.7200	-0.50	1.7120	1.7010	1.7310	1.9075	1.1575	3.3050	1.1575
7Y	1.7925	-0.50	1.7810	1.7781	1.8085	2.0075	1.1675	3.4625	1.1675
10Y	1.9000	-0.50	1.8835	1.8739	1.9089	2.1300	1.2125	3.6250	1.2125
12Y	1.9400	-0.50	1.9245	1.9130	1.9439	2.1875	1.2150	3.6575	1.2150
15Y	1.9450	-0.50	1.9300	1.9175	1.9432	2.2200	1.2150	3.6675	1.2150
20Y	1.9425	-0.50	1.9265	1.9100	1.9133	2.2475	1.2150	3.8075	1.2150
6*9M	3.00	0.00	2.75	1.86	1.13	3.00	-6.00	4.25	-6.50
9*12M	2.50	0.00	2.15	1.49	1.12	2.50	-4.00	4.50	-5.75
1*2Y	7.75	-0.25	7.70	7.09	6.54	9.00	-5.50	16.25	-8.75
2*3Y	6.25	0.00	6.15	6.20	6.30	8.00	-1.75	15.00	-1.75
2*4Y	11.50	0.00	11.10	11.29	11.80	16.50	-1.75	28.25	-1.75
2*5Y	16.50	0.25	15.65	15.96	16.82	23.75	-1.75	39.25	-1.75
3*4Y	5.25	0.00	4.95	5.09	5.51	8.75	-0.50	14.00	-0.50
3*5Y	10.25	0.25	9.50	9.76	10.53	16.00	-0.50	25.00	-0.50
4*5Y	5.00	0.25	4.55	4.68	5.02	7.25	-0.25	11.75	-0.25
5*7Y	7.25	0.00	6.90	7.71	7.76	10.50	0.25	16.25	0.25
5*10Y	18.00	0.00	17.15	17.29	17.80	22.25	3.75	32.25	3.75
7*10Y	10.75	0.00	10.25	9.58	10.04	12.75	3.00	16.75	3.00
10*12Y	4.00	0.00	4.10	3.91	3.50	5.75	-0.25	7.75	-0.25
10*15Y	4.50	0.00	4.65	4.36	3.43	9.00	-0.75	15.00	-0.75
10*20Y	4.25	0.00	4.30	3.61	0.43	12.00	-11.00	31.00	-11.00

BOND			BOND SWAP SPRD (1-2Y 통안, 3-10Y 국고,금투협 시가평가 민평평균 기준)						
Tenor	Lv.	전일비	Tenor	Lv.	전일비	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
1Y	1.4600	-1.00	1Y	1.75	0.50	5.75	-17.75	13.00	-17.75
1.5Y	1.5450	-1.20	1.5Y	-2.25	0.45	-0.20	-19.10	9.75	-19.10
2Y	1.6050	-1.20	2Y	-5.00	0.45	-1.95	-25.15	9.50	-25.15
3Y	1.6700	-1.00	3Y	-5.25	0.25	4.75	-19.50	11.00	-19.50
4Y	1.7900	-1.20	4Y	-12.00	0.45	-3.20	-30.35	5.75	-30.35
5Y	1.8600	-1.00	5Y	-14.00	0.50	-2.25	-27.25	8.50	-27.25
7Y	2.0820	-1.00	7Y	-28.95	0.50	-7.50	-37.65	2.00	-37.65
10Y	2.1950	-0.50	10Y	-29.50	0.00	-12.95	-37.25	6.00	-37.25

BASIS SWAP			CRS				USD/KRW	1130.10	(+5.00)
Tenor	Lv.	전일비	Lv.	전일비	1Y Max	1Y Min	SPRD	Lv.	전일비
1Y	-55.25	-1.00	0.9250	-1.50	1.4000	0.7650	1*2Y	9.50	-1.00
1.5Y	-55.75	-1.25	0.9650	-2.00	1.2850	0.8100	2*3Y	10.50	0.50
2Y	-53.50	-1.75	1.0200	-2.50	1.2600	0.7950	2*5Y	19.00	0.50
3Y	-49.25	-1.25	1.1250	-2.00	1.3550	0.7350	3*4Y	6.00	0.00
4Y	-48.50	-1.25	1.1850	-2.00	1.4050	0.6900	3*5Y	8.50	0.00
5Y	-51.00	-1.50	1.2100	-2.00	1.4500	0.6600	4*5Y	2.50	0.00
7Y	-53.75	-2.00	1.2550	-2.50	1.4900	0.6550	5*7Y	4.50	-0.50
10Y	-52.00	-2.50	1.3800	-3.00	1.9050	0.6300	5*10Y	17.00	-1.00

TODAY DEAL LEVEL

IRS	Lv.		
06M	42	ODD Tenor	
09M	45.75		
01Y	17.75 / 48 / 48.25		
1.5Y	52.5		
02Y	55.5	SPRD	1*2*5y fly -8.25
03Y	61.75 / 62		
04Y	67.25		
05Y	72 / 72.5 / 72.75		
07Y			
10Y	90.5		
12Y			
15Y			
20Y			
CRS	2y 02		

TODAY KRX CCP		국채선물	Lv.	전일비	시	고	저
거래현황	93건(-13건)	KTB	109.45	0.03	109.41	109.46	109.36
금 액	25,665억원(-1,377억원)	LKTB	124.9	0.03	124.83	124.95	124.77

장중동향

한국은행이 27일 발표한 올해 1분기 경제성장률이 시장 예상치를 웃도는 '서프라 이즈' 수준으로 평가됐지만 외국인과 증권사가 쌍끌이 매수에 나서면서 가격 상승. 유일호 부총리 겸 기획재정부 장관은 이날 ""국내 경제 회복세에도 장기간의 위축 에서 벗어나 확장적 선순환 국면으로 진입했다고 장담하기에는 이르다""고 밝혀 매수 세를 자극.

IRS는 채권금리와 연동해 움직이며 하락 마감. 최근 본드스왑이 반등하면서 그간 들고있은 본드스왑 포지션을 정리하는 오퍼가 많이 나왔고, 거래는 장기보다는 단기에서 중기까지로 집중. 커브는 큰 변화없이 전테너 0.5~0.75bp정도 하락 마감.

CRS는 최근 부채스왑물량으로 레벨이 오르다가 다시 에셋 영향을 받으며 하락 마감.

ETC

한은, 5월 통안증권 13.5조 발행...전월비 1.4조↓

한은RP 14일물 1.26%에 6.0조 낙찰...7일물 10.0조 낙찰